

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
MERC. COT. OFICIAIS DE BOLSA VAL. PORT.						40 184
Ações						
EDP Renováveis	1 782	22.55	EUR	22.55		40 184
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					110 831	79 309 493
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	982 000	104.64%	EUR	104.64%	14 167	1 041 751
BKO 0% 09/2021	1 000 000	100.39%	EUR	100.39%		1 003 880
FRTR 4.25% 10/2023	300 000	113.66%	EUR	113.66%	3 458	344 423
FRTR 3% 04/2022	1 700 000	104.48%	EUR	104.48%	39 403	1 815 478
FRTR 0.25% 11/26	4 740 000	104.84%	EUR	104.84%	2 208	4 971 434
SPGB 1.95% 07/2030	300 000	117.90%	EUR	117.90%	2 981	356 684
SPGB 3.45% 07/66	480 000	177.04%	EUR	177.04%	8 439	858 236
SPGB 0.45% 10/22	1 800 000	101.77%	EUR	101.77%	2 064	1 833 978
BTPS 4% 2/2037	300 000	142.94%	EUR	142.94%	6 000	434 823
BTPS 2% 12/2025	2 100 000	109.54%	EUR	109.54%	7 154	2 307 515
BTPS 3.45% 03/48	1 136 000	144.61%	EUR	144.61%	16 565	1 659 323
RAGB 0% 07/2023	1 165 000	101.65%	EUR	101.65%		1 184 176
IRISH 0% 10/22	400 000	101.13%	EUR	101.13%		404 520
CCTS Float 07/2023	1 300 000	100.95%	EUR	100.95%	106	1 312 482
						19 528 702
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	102.10%	EUR	102.10%		510 510
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.83%	EUR	99.83%		598 950
VW Float 07/21	200 000	100.09%	EUR	100.09%		200 176
SAPGR Float 03/21	300 000	100.03%	EUR	100.03%		300 081
VW Float 12/21	1 700 000	100.29%	EUR	100.29%	436	1 705 315
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	100.72%	EUR	100.72%	40	1 007 190
DB Float 05/2022	2 400 000	100.31%	EUR	100.31%	1 473	2 408 937
ACAFP Float 04/22	1 500 000	100.81%	EUR	100.81%	124	1 512 259
SOCGEN Float 05/24	500 000	101.14%	EUR	101.14%	265	505 950
BNP Float 06/24	1 000 000	101.11%	EUR	101.11%	347	1 011 427
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.15%	EUR	100.15%	68	400 664
GFCFP Float 06/22	500 000	100.22%	EUR	100.22%		501 090
RENAULT Float 11/24	400 000	98.16%	EUR	98.16%	49	392 673
BNP Float 05/23	300 000	100.76%	EUR	100.76%	54	302 343
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.47%	EUR	100.47%		602 790
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.37%	EUR	100.37%	269	1 907 204
HSBC Float 09/22	100 000	100.37%	EUR	100.37%	15	100 384
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.06%	EUR	101.06%	279	1 010 899
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.43%	EUR	100.43%		1 506 390
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.18%	EUR	100.18%		801 456
RBS Float 09/21	1 200 000	100.49%	EUR	100.49%	419	1 206 287
RBS Float 03/21	500 000	100.04%	EUR	100.04%	62	500 257
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.63%	EUR	100.63%	348	1 207 932
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.96%	EUR	100.96%	559	1 010 189
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.53%	EUR	100.53%	28	1 005 308
AMSSM Float 03/22	700 000	99.60%	EUR	99.60%		697 221

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SANTAN Float 03/23	500 000	100.79%	EUR	100.79%	102	504 067
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.69%	EUR	100.69%	144	1 007 074
BACRED Float 05/22	1 000 000	100.56%	EUR	100.56%	579	1 006 209
FCABNK Float 06/21	500 000	100.08%	EUR	100.08%		500 385
GS Float 07/2021	200 000	100.45%	EUR	100.45%	13	200 921
WFC Float 01/22	1 400 000	100.39%	EUR	100.39%		1 405 502
BAC Float 02/22	600 000	100.05%	EUR	100.05%	396	600 666
BAC Float 05/23	150 000	100.60%	EUR	100.60%	96	150 998
MS Float 11/22	1 200 000	100.40%	EUR	100.40%	512	1 205 348
GM Float 05/21	800 000	100.03%	EUR	100.03%	308	800 548
BATSLN Float 08/21	500 000	100.10%	EUR	100.10%		500 495
F Float 12/22	300 000	96.75%	EUR	96.75%		290 235
C Float 03/23	1 650 000	100.58%	EUR	100.58%		1 659 537
GM Float 03/22	300 000	99.82%	EUR	99.82%	3	299 460
BAC FLOAT 04/24	800 000	100.63%	EUR	100.63%	24	805 088
T Float 09/23	1 500 000	101.20%	EUR	101.20%	801	1 518 741
FIS Float 05/2021	500 000	100.05%	EUR	100.05%		500 260
GS Float 04/2023	500 000	100.19%	EUR	100.19%	0	500 955
SCANIA Float 03/21	200 000	100.03%	EUR	100.03%		200 060
DAIGR Float 05/22	500 000	100.20%	EUR	100.20%		500 995
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.27%	EUR	100.27%	13	1 504 078
INTNED Float 09/23	600 000	101.56%	EUR	101.56%	216	609 546
INTNED Float 11/21	200 000	100.40%	EUR	100.40%		200 802
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.42%	EUR	100.42%		200 836
INTNED Float 04/22	200 000	100.57%	EUR	100.57%		201 138
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.40%	EUR	100.40%		1 606 368
NYKRE Float 06/22	700 000	100.45%	EUR	100.45%	52	703 167
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.66%	EUR	100.66%		301 972
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.26%	EUR	100.26%		200 526
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.01%	EUR	101.01%	24	606 096
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.04%	EUR	100.04%		400 156
SBBBSS Float 2/2023	300 000	100.04%	EUR	100.04%		300 123
KBCBB Float 11/22	1 600 000	100.66%	EUR	100.66%	67	1 610 675
ABIBB Float 04/24	1 600 000	100.46%	EUR	100.46%		1 607 296
DLTAS 2008-1 A	322 250	99.78%	EUR	99.78%		321 541
DHR Float 06/22	950 000	100.18%	EUR	100.18%		951 672
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.43%	EUR	100.43%		2 108 925
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.51%	EUR	100.51%		1 507 620
MUFG Float 05/2023	1 400 000	100.48%	EUR	100.48%	54	1 406 746
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.86%	EUR	100.86%		706 013
BMO Float 03/22	200 000	100.48%	EUR	100.48%		200 960
GS Float 07/2022	600 000	101.01%	EUR	101.01%	46	606 118
GE FLOAT 5/21	1 700 000	100.05%	EUR	100.05%		1 700 884
						56 124 177
Ações						
BMW	754	70.01	EUR	70.01		52 788
DEUTSCHE BANK	5 199	8.37	EUR	8.37		43 510
SIEMENS	1 037	127.94	EUR	127.94		132 674
ALLIANZ	225	186.52	EUR	186.52		41 967
BASF	910	63.83	EUR	63.83		58 085
BAYER AG	1 888	49.92	EUR	49.92		94 240

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RWE-RHEINISCH WEST..	438	35.46	EUR	35.46		15 531
ADIDAS- SALOMON AG	153	262.00	EUR	262.00		40 086
SAP SE	663	104.80	EUR	104.80		69 482
DEUTSCHE TELEKOM	4 801	14.70	EUR	14.70		70 575
DAIMLER CHRYSLER	528	58.12	EUR	58.12		30 687
INFINEON TECHNOLOGIE	401	33.13	EUR	33.13		13 283
DEUTSCHE POST	2 050	40.81	EUR	40.81		83 661
FRESENIUS SE&CO KGAA	753	36.77	EUR	36.77		27 688
SIEMENS HEALTHIN	727	46.28	EUR	46.28		33 646
Siemens Energy AG	519	30.58	EUR	30.58		15 871
DANONE	767	54.96	EUR	54.96		42 154
AXA-UAP	939	18.30	EUR	18.30		17 184
PERNOD RICARD	355	155.70	EUR	155.70		55 274
TOTAL SE	2 531	34.90	EUR	34.90		88 319
L OREAL	355	290.10	EUR	290.10		102 986
Kering	82	541.60	EUR	541.60		44 411
BNP	1 766	39.78	EUR	39.78		70 251
AIR LIQUIDE	453	135.00	EUR	135.00		61 155
SCHNEIDER	293	120.95	EUR	120.95		35 438
L.V.M.H.	317	498.30	EUR	498.30		157 961
MICHELIN	173	113.90	EUR	113.90		19 705
SAINT-GOBAIN	853	41.08	EUR	41.08		35 041
BOUYGUES	572	32.42	EUR	32.42		18 544
EssilorLuxottica	285	117.00	EUR	117.00		33 345
GLE ENTREP. VINCI	610	76.58	EUR	76.58		46 714
ST MICROELECTRON	1 558	33.27	EUR	33.27		51 835
DASSAULT SYSTEMES	208	164.75	EUR	164.75		34 268
SANOFI SYNHLABO	1 061	77.15	EUR	77.15		81 856
AIRBUS SE	729	83.20	EUR	83.20		60 653
CREDIT AGRICOLE SA	3 749	9.38	EUR	9.38		35 166
ILIAD SA	204	152.65	EUR	152.65		31 141
SAFRAN SA	177	104.10	EUR	104.10		18 426
HERMES INTERNACIONAL	30	842.60	EUR	842.60		25 278
TELEPERFORMANCE	78	270.20	EUR	270.20		21 076
RECKITT BENCKISER	369	61.98	GBP	70.09		25 862
ANGLO AMERICAN PLC	826	24.14	GBP	27.30		22 548
OCADO GROUP PLC	1 134	27.77	GBP	31.40		35 610
TELEFONICA	3 973	3.55	EUR	3.55		14 120
BCO SANTANDER C.HISP	24 722	2.42	EUR	2.42		59 704
IBERDROLA	5 991	11.19	EUR	11.19		67 009
REPSOL	1 620	8.12	EUR	8.12		13 158
FERROVIAL	627	19.81	EUR	19.81		12 418
INDITEX	1 672	24.49	EUR	24.49		40 947
TELECOM ITALIA	46 811	0.35	EUR	0.35		16 543
UNICREDITO ITALIANO	4 902	7.56	EUR	7.56		37 044
ENI SPA	1 345	8.35	EUR	8.35		11 233
ENEL	8 341	8.19	EUR	8.19		68 321
ESSITY AKTIEBO-B	847	267.30	SEK	26.42		22 374
ASML NA	514	439.45	EUR	439.45		225 877
AKZO NOBEL NV NLG20	408	83.84	EUR	83.84		34 207
DSM NV	278	144.00	EUR	144.00		40 032
STELLANTIS NV	4 643	12.53	EUR	12.53		58 177

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Prosus NV	523	95.82	EUR	95.82		50 114
Adyen NV	10	1 719.50	EUR	1 719.50		17 195
SAMPO OYJ-A SHS	1 645	34.68	EUR	34.68		57 049
Neste Oyj	445	58.28	EUR	58.28		25 935
KBC BANKVERZEKERING	970	57.72	EUR	57.72		55 988
ANHEUSER-BUSCH INB	966	51.98	EUR	51.98		50 213
ERST BK DER OEST.SPA	1 766	25.25	EUR	25.25		44 592
CRH ORD	811	34.38	EUR	34.38		27 882
						3 146 105
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					2 199	5 098 139
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	200 000	101.06%	EUR	101.06%		202 112
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	99.04%	EUR	99.04%		990 360
F Float 05/21	250 000	99.67%	EUR	99.67%		249 170
UBS Float 09/22	1 500 000	100.37%	EUR	100.37%	278	1 505 783
CS Float 01/2026	500 000	101.07%	EUR	101.07%	88	505 438
TACHEM Float 11/22	1 600 000	101.40%	EUR	101.40%	1 834	1 624 186
						4 874 936
Ações						
ZURICH ALLIED AG	64	356.20	CHF	329.54		21 091
						84 447 816
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						12 057 444
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.03	EUR	4.03		2 863 115
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.65	EUR	5.65		228 997
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.39	EUR	7.39		589 636
Fundimo	1 061 545	7.89	EUR	7.89		8 375 696
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 153 761
ALLIANZ EUOLD EQY G	227	3 254.30	EUR	3 254.30		738 726
SCHRODER ISF EURO EQ	65 998	47.09	EUR	47.09		3 107 536
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 307.49	EUR	2 307.49		2 413 635
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 191.00	EUR	217 191.00		651 573
EAST-US CB-CE HG	76 489	12.12	EUR	12.12		927 353
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	11.52	EUR	11.52		940 308
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	39.21	EUR	39.21		1 316 084
AB SCV I-EUZ EQ I	102 190	29.93	EUR	29.93		3 058 547
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 150
TISHMAN ESO	91 579	0.02	EUR	0.02		2 150
						25 213 355
OUTROS ACTIVOS						
Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	461 000.00	EUR	461 000.00		2 305 000
REPUBLICA 35- R/C	8	625 075.00	EUR	625 075.00		5 000 600
						7 305 600
						7 305 600

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						2 565 819
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			589
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			51
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 751 700
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			277 033
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 906
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			73
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			383
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 847
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			530 236
						2 565 819
						2 565 819
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						103 394
VALORES PASSIVOS						-490 289
						-386 894
						119 145 696
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH1 EUR EUX 03/21	17	3 468.00	EUR	3 468.00		589 560
ESH1 S&P500 03/21	4	3 710.00	USD	3 057.27		611 454
						1 201 014
						1 201 014
						1 201 014
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						8 648 878.72
Valor da Unidade de Participação: € 13.7759						